

工银理财·恒睿睿盈私银尊享120天持盈混合类开放式理财产品 (21HH6886) 2022年第一季度季报

1、重要提示

尊敬的客户，感谢您选择工银理财！您购买的本款产品是由工银理财有限责任公司自主设计、投资、运作的理财产品。业绩比较基准是本机构基于产品性质、投资策略、过往经验等因素对产品设定的投资目标，不代表产品的未来表现和实际收益，不构成对产品收益的承诺。理财非存款、产品有风险、投资须谨慎。

2、理财产品概况

产品名称	工银理财·恒睿睿盈私银尊享120天持盈混合类开放式理财产品
产品代码	21HH6886
销售币种	人民币
产品风险评级	PR3
收益类型	非保本浮动收益
产品成立日	2021年06月21日
产品到期日	--
开放日	封闭期结束后每个工作日为开放日，如遇非工作日，开放日顺延，首个开放日为2021年7月19日
开放时间	开放日的9:00至17:00为开放时间
购买、赎回方式	1. 封闭期过后，客户可于开放日的09:00至17:00进行申购或赎回(赎回份额需满足【最短持有期限】条件)，投资管理人在开放日后2个工作日内确认客户申购或赎回是否成功。2. 当产品规模超过规模上限30亿元时，工银理财有限责任公司有权暂停购买。工银理财有限责任公司亦有权根据市场或监管政策变化情况暂停或停止购买。
业绩比较基准	本产品为净值型产品，其业绩表现将随市场波动，具有不确定性。本产品业绩比较基准为3.35%（年化），该业绩比较基准仅作为计算浮动管理费的依据，不构成工银理财对该理财产品的任何收益承诺。
托管费率（年）	0.02%
销售手续费率（年）	0.30%
杠杆水平	104.86%
产品托管人	工商银行重庆分行
报告期末理财产品份额	1,273,912,229.32

3、产品净值表现

截至2022年03月31日，产品净值为0.9706，累计净值为0.9706，产品资产净值1236449230.54。

4、市场情况及产品运作回顾

4.1、市场回顾

市场方面，2022年一季度股债市场分化显著，十年期国债中债估值到期收益率走出V型走势，从2.78%下行至2.67%，之后再回升至2.79%；A股方面一季度整体呈下跌态势，市场调整较为剧烈。2022年一季度上证综指跌10.65%，沪深300指数跌14.53%，创业板指跌19.96%。A股行业板块层面多数下跌，仅4个行业取得正收益，涨幅前四的分别为煤炭、房地产、银行、农林牧渔；跌幅靠前三位的行业为电子、国防军工、汽车。商品市场方面，南华商品指数上涨23%。

4.2、操作回顾

结合产品净值情况和市场情况，按照股债平衡的思路开展资产配置，固收资产方面以信用优选为核心，适当参与久期策略，权益资产方面跟踪行业景气度，配置权益类资产。

4.3、下一步投资策略

根据资产配置方案，实时监测市场情况，适当降低权益类资产比例，寻找投资机会。

5、投资组合报告

5.1 投资组合概况

本产品直接投资的资产比例为25.71%，间接投资的比例为74.29%。其中直接投资固收类100.00%、权益类0.00%、商品及衍生品类0.00%、公募基金0.00%；间接投资固收类52.48%、权益类0.19%、商品及衍生品类4.07%、公募基金43.26%。本产品投资的商品及金融衍生品类资产用于资产配置、对冲，规模合计为39214044.63元，占产品总资产3.02%，其中规模合计为商品及金融衍生品类资产占用的保证金。

5.2 投资组合基本情况

序号	资产种类	占投资组合的比例 (%)
※	固定收益类	64.70%
	货币类	38.26%
	债券类	26.44%
※	权益类	0.14%
	股票类	0.14%
※	商品及金融衍生品类	3.02%
	衍生品类	3.02%
※	基金	32.14%
	公募基金	32.14%
合计		100%

5.3 产品投资前十项资产明细

序号	资产名称	规模	规模占比 (%)
1	中信期货工银量化精选1号	378376434.56	30.60%
2	国信证券稳1号集合资产管理计划	251252314.51	20.32%
3	活期存款	213174157.82	17.24%
4	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	64677703.13	5.23%
5	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	60076552.32	4.86%
6	21HH6886存浙江0330	60000000.00	4.85%
7	证券清算款	60000000.00	4.85%
8	中信期货工银量化精选2号	51205303.25	4.14%
9	光大期货多策略2号集合资产管理计划	48994356.02	3.96%
10	工银瑞投-工银理财四海甄选集合资产管理计划	19638189.22	1.59%

5.4 产品投资前十名债券明细

债券代码	债券名称	占投资组合的比例 (%)
无		

5.5 产品投资前十名股票明细

股票代码	股票名称	占投资组合的比例 (%)
无		

5.6 报告期末产品投资非标准化债权类资产明细

序号	融资客户	投资品名称	剩余融资期限 (月)	投资品年收益率 (%)	投资模式	是否存在风险	占投资组合的比例 (%)
无							

5.7 投资组合流动性风险分析

本产品的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易场所或者银行间同业市场交易，组合变现比例能力较好。

6、其他重要信息

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银新蓝筹股票A(证券代码: 001651.OF), 期末持仓数量为959739.38, 期末价格为2.5, 标的资产类别为基金; 工银新金融股票(证券代码: 001054.OF), 期末持仓数量为1355299.66, 期末价格为2.84, 标的资产类别为基金; 工银稳健成长混合A(证券代码: 481004.OF), 期末持仓数量为7776421.42, 期末价格为1.21, 标的资产类别为基金; 工银瑞信双利债券A(证券代码: 485111.OF), 期末持仓数量为878894.37, 期末价格为1.7, 标的资产类别为基金; 工银美丽城镇股票A(证券代码: 001043.OF), 期末持仓数量为4468753.36, 期末价格为2.64, 标的资产类别为基金; 工银量化策略混合(证券代码: 481017.OF), 期末持仓数量为1588773.04, 期末价格为3.71, 标的资产类别为基金; 工银精选平衡混合(证券代码: 483003.OF), 期末持仓数量为7762352.65, 期末价格为0.62, 标的资产类别为基金; 工银大盘蓝筹混合(证券代码: 481008.OF), 期末持仓数量为1585472.5, 期末价格为1.19, 标的资产类别为基金; 报告期内投资于中国工商银行承销的22邮储银行永续债01(证券代码: 2228001.IB), 期末持仓数量为2251974.35, 期末价格为99.81, 标的资产类别为债券; 22农业银行永续债01(证券代码: 2228011.IB), 期末持仓数量为2251974.35, 期末价格为99.53, 标的资产类别为债券; 22农业银行永续债01(证券代码: 2228011.IB), 期末持仓数量为281107.25, 期末价格为99.53, 标的资产类别为债券; 22农业银行永续债01(证券代码: 2228011.IB), 期末持仓数量为276671.49, 期末价格为99.53, 标的资产类别为债券; 22华商银行01(证券代码: 2226002.IB), 期末持仓数量为180157.95, 期末价格为100.06, 标的资产类别为债券; 21中盈万家3A2_bc(证券代码: 2189209.IB), 期末持仓数量为687798.35, 期末价格为101.28, 标的资产类别为债券; 21中信银行永续债(证券代码: 2128017.IB), 期末持仓数量为900789.74, 期末价格为106.22, 标的资产类别为债券; 21中金集MTN001(证券代码: 102100753.IB), 期末持仓数量为720631.79, 期末价格为104.35, 标的资产类别为债券; 21中节能GN003(证券代码: 132100170.IB), 期末持仓数量为270236.92, 期末价格为100.93, 标的资产类别为债券; 21中国银行永续债01(证券代码: 2128019.IB), 期末持仓数量为562214.5, 期末价格为105.56, 标的资产类别为债券; 21中国银行永续债01(证券代码: 2128019.IB), 期末持仓数量为900789.74, 期末价格为105.56, 标的资产类别为债券; 21中国银行二级01(证券代码: 2128008.IB), 期末持仓数量为69167.87, 期末价格为103.02, 标的资产类别为债券; 21中国银行二级01(证券代码: 2128008.IB), 期末持仓数量为1035908.2, 期末价格为103.02, 标的资产类别为债券; 21招商银行永续债(证券代码: 2128047.IB), 期末持仓数量为6305528.18, 期末价格为101.1, 标的资产类别为债券; 21邮储银行永续债01(证券代码: 2128011.IB), 期末持仓数量为281107.25, 期末价格为103.45, 标的资产类别为债券; 21邮储银行永续债01(证券代码: 2128011.IB), 期末持仓数量为450394.87, 期末价格为103.45, 标的资产类别为债券; 21邮储银行二级01(证券代码: 2128028.IB), 期末持仓数量为1124429.01, 期末价格为102.02, 标的资产类别为债券; 21川高速MTN005(证券代码: 102100755.IB), 期末持仓数量为450394.87, 期末价格为104.47, 标的资产类别为债券; 21三一MTN001(证券代码: 102101031.IB), 期末持仓数量为196775.08, 期末价格为103.6, 标的资产类别为债券; 21浦鑫安居2A2(证券代码: 2189551.IB), 期末持仓数量为1640186.83, 期末价格为100.54, 标的资产类别为债券; 21浦鑫安居2A1(证券代码: 2189550.IB), 期末持仓数量为267662.09, 期末价格为100.19, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓3A3(证券代码: 2189538.IB), 期末持仓数量为2503733.53, 期末价格为100.85, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓3A2(证券代码: 2189537.IB), 期末持仓数量为1035016.2, 期末价格为100.58, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓3A1(证券代码: 2189536.IB), 期末持仓数量为910055.59, 期末价格为100.18, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓2A3(证券代码: 2189503.IB), 期末持仓数量为2151566.06, 期末价格为101.1, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓2A2(证券代码: 2189502.IB), 期末持仓数量为1325555.19, 期末价格为100.68, 标的资产类别为债券; 21农盈汇寓2A1(证券代码: 2189501.IB), 期末持仓数量为1094995.67, 期末价格为100.2, 标的资产类别为债券; 21农业银行永续债01(证券代码: 2128038.IB), 期末持仓数量为6755923.05, 期末价格为101.91, 标的资产类别为债券; 21民生银行永续债01(证券代码: 2128016.IB), 期末持仓数量为1124429.01, 期末价格为101.27, 标的资产类别为债券; 21聚盈京能ABN001优先(证券代码: 082101014.IB), 期末持仓数量为911378.26, 期末价格为100.55, 标的资产类别为债券; 21进出16(证券代码: 210316.IB), 期末持仓数量为553342.97, 期末价格为103.25, 标的资产类别为债券; 21锦江国际MTN001(证券代码: 102100796.IB), 期末持仓数量为281107.25, 期末价格为105.04, 标的资产类别为债券; 21金地MTN005(证券代码: 102101091.IB), 期末持仓数量为450394.87, 期末价格为101.75, 标的资产类别为债券; 21

金地MTN004(证券代码: 102100991. IB), 期末持仓数量为562214. 5, 期末价格为101. 8, 标的资产类别为债券; 21交通银行永续债(证券代码: 2128022. IB), 期末持仓数量为1801579. 48, 期末价格为105. 19, 标的资产类别为债券; 21交通银行二级(证券代码: 2128030. IB), 期末持仓数量为1801579. 48, 期末价格为102. 59, 标的资产类别为债券; 21建设银行二级01(证券代码: 2128025. IB), 期末持仓数量为1801579. 48, 期末价格为102. 21, 标的资产类别为债券; 21华为MTN002(证券代码: 102100344. IB), 期末持仓数量为900789. 74, 期末价格为101. 39, 标的资产类别为债券; 21华侨城MTN002A(乡村振兴)(证券代码: 102100893. IB), 期末持仓数量为590325. 23, 期末价格为104. 18, 标的资产类别为债券; 21广晟MTN001(证券代码: 102100445. IB), 期末持仓数量为540473. 84, 期末价格为101. 94, 标的资产类别为债券; 21戴姆勒财PPN004BC(证券代码: 032100573. IB), 期末持仓数量为843321. 76, 期末价格为103. 34, 标的资产类别为债券; 21戴姆勒财PPN002BC(证券代码: 032100336. IB), 期末持仓数量为138335. 74, 期末价格为100. 37, 标的资产类别为债券; 21大唐集MTN006(证券代码: 102102138. IB), 期末持仓数量为900789. 74, 期末价格为102. 15, 标的资产类别为债券; 21川高速MTN005(证券代码: 102100755. IB), 期末持仓数量为675592. 3, 期末价格为104. 47, 标的资产类别为债券; 21成渝高速MTN001(证券代码: 102100999. IB), 期末持仓数量为421660. 88, 期末价格为103. 67, 标的资产类别为债券; 21奔驰汽车债02(证券代码: 2122035. IB), 期末持仓数量为1351184. 61, 期末价格为103. 97, 标的资产类别为债券; 20中核MTN002(证券代码: 102002011. IB), 期末持仓数量为252996. 53, 期末价格为102. 2, 标的资产类别为债券; 20中国银行二级01(证券代码: 2028038. IB), 期末持仓数量为1801579. 48, 期末价格为105. 31, 标的资产类别为债券; 20邮储银行永续债(证券代码: 2028006. IB), 期末持仓数量为41500. 72, 期末价格为101. 4, 标的资产类别为债券; 20邮储银行永续债(证券代码: 2028006. IB), 期末持仓数量为1125987. 18, 期末价格为101. 4, 标的资产类别为债券; 20上汽通用债(证券代码: 2022018. IB), 期末持仓数量为96835. 02, 期末价格为102. 44, 标的资产类别为债券; 20浦发银行永续债(证券代码: 2028051. IB), 期末持仓数量为945829. 23, 期末价格为106. 02, 标的资产类别为债券; 20浦发银行二级03(证券代码: 2028034. IB), 期末持仓数量为69167. 87, 期末价格为105. 35, 标的资产类别为债券; 20浦发银行二级01(证券代码: 2028025. IB), 期末持仓数量为1013388. 46, 期末价格为104. 38, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于中国工商银行交易的20京能电力MTN001(证券代码: 102001636. IB), 期末持仓数量为138335. 74, 期末价格为104. 23, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于中国工商银行交易的20京能电力MTN001(证券代码: 102001636. IB), 期末持仓数量为1486303. 07, 期末价格为104. 23, 标的资产类别为债券; 20交通银行二级(证券代码: 2028018. IB), 期末持仓数量为1351184. 61, 期末价格为103. 03, 标的资产类别为债券; 20光穗南电ABN001优先(证券代码: 082001001. IB), 期末持仓数量为1139696. 6, 期末价格为101. 67, 标的资产类别为债券; 20光大银行永续债(证券代码: 2028037. IB), 期末持仓数量为1125987. 18, 期末价格为106. 24, 标的资产类别为债券; 20工银租赁债02(证券代码: 2022048. IB), 期末持仓数量为140553. 63, 期末价格为102. 9, 标的资产类别为债券; 19中核MTN005A(证券代码: 101901633. IB), 期末持仓数量为140553. 63, 期末价格为101. 99, 标的资产类别为债券; 19中国银行二级03(证券代码: 1928033. IB), 期末持仓数量为810710. 77, 期末价格为103. 8, 标的资产类别为债券; 19平安银行二级(证券代码: 1928010. IB), 期末持仓数量为1035908. 2, 期末价格为107. 26, 标的资产类别为债券; 19农业银行永续债02(证券代码: 1928023. IB), 期末持仓数量为450394. 87, 期末价格为104. 81, 标的资产类别为债券; 19农业银行永续债01(证券代码: 1928021. IB), 期末持仓数量为900789. 74, 期末价格为105. 52, 标的资产类别为债券; 19交通银行永续债(证券代码: 1928025. IB), 期末持仓数量为630552. 82, 期末价格为104. 66, 标的资产类别为债券; 19光穗节能ABN001优先(证券代码: 081900685. IB), 期末持仓数量为183875. 47, 期末价格为99. 97, 标的资产类别为债券; 19戴姆勒PPN003BC(证券代码: 031900827. IB), 期末持仓数量为138335. 74, 期末价格为102. 18, 标的资产类别为债券;